

Warszawa, 21 marca 2024r.

VIG / C-QUADRAT FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

Informacja o technikach efektywnego zarządzania portfelem, w tym o umowach mających za przedmiot instrumenty pochodne.

Zgodnie z pkt. 35 i pkt. 40 Wytycznych dotyczących funduszy typu ETF i innych kwestii związanych z UCITS wydanych 1 sierpnia 2014 r. przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA/2014/937PL) Zarząd VIG / C-QUADRAT Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. („Towarzystwo”) przedstawia poniższe informacje.

Fundusz może stosować techniki efektywnego zarządzania portfelem inwestycyjnym Funduszu pod warunkiem, że są one zgodne z celem inwestycyjnym Subfunduszu. Stosowanie technik efektywnego zarządzania portfelem inwestycyjnym Subfunduszu realizowane jest poprzez zawieranie umów mających za przedmiot instrumenty pochodne, w tym także niewystandaryzowane instrumenty pochodne.

Transakcje na instrumentach pochodnych, w tym niewystandaryzowanych instrumentach pochodnych, zawierane przez Fundusz w celu zapewnienia sprawnego zarządzania portfelem inwestycyjnym Subfunduszu, mogą być transakcjami terminowymi (futures lub forward) lub opcjami, w których instrumentami bazowymi są indeksy giełdowe lub papiery wartościowe lub Instrumenty Rynku Pieniężnego, które mogą być przedmiotem lokat Subfunduszu, lub kursy walut, lub umowami o przyszłe stopy procentowe, lub transakcjami wymiany stóp procentowych (swapami stóp procentowych), lub też swapami walutowymi. Zawieranie umów mających za przedmiot instrumenty pochodne bez względu na ich cel może odbywać się wyłącznie pod warunkami i na zasadach określonych w Ustawie oraz w rozporządzeniu Ministra Finansów w sprawie zawierania przez fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne, oraz przy uwzględnieniu celu inwestycyjnego Subfunduszu.

Na dzień bilansowy ekspozycja VIG / C-QUADRAT FIO uzyskana poprzez techniki efektywnego zarządzania portfelem w Subfunduszach wyglądała następująco:

Nazwa Subfunduszu	Rodzaj transakcji	Tożsamość kontrahenta	Wartość ekspozycji bazowej na dzień bilansowy (w tys. zł)	Wartość ekspozycji na dzień bilansowy (w tys. zł)	Wartość otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)
VIG / C-QUADRAT Konserwatywny	brak			nie dotyczy	
VIG / C-QUADRAT Obligacji	brak			nie dotyczy	
VIG / C-QUADRAT Obligacji Korporacyjnych	brak			nie dotyczy	
VIG / C-QUADRAT Akcji	brak			nie dotyczy	
VIG / C-QUADRAT Global Growth Trends	brak			nie dotyczy	

Dochody wynikające z technik efektywnego zarządzania portfelem inwestycyjnym Subfunduszu z uwzględnieniem poniesionych kosztów i opłat w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły.

Podpisy osób reprezentujących Fundusz:

Michał Szymański
Prezes Zarządu VIG / C-QUADRAT TFI

Aleksandra Kik
Członek Zarządu VIG / C-QUADRAT TFI